

PRINLS1

PRINCIPAL SAM I, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE RENTA VARIABLE

DISCRECIONAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			132,074,938	2.89%
M	BONOS	270603	AAA(mex)	132,074,938	2.89 %
	Chequera dolares			20,446	- %
CHD	40-002	9079993	N/A	20,446	0.00 %
	Soc. de Inv. de Renta Variable			564,696,502	12.37%
52	PRINRVA	FFR	N/A	236,189,756	5.17 %
52	PEMERGE	FFR	N/A	202,473,169	4.43 %
52	PRGLOB	FFR	N/A	91,352,883	2.00 %
52	PRINFUS	FFX	N/A	34,680,694	0.76 %
	Sociedad de Inversion de Deuda			3,051,917,542	66.84%
51	PRINFGU	FFX	AAAf/S2(me	711,799,618	15.59 %
51	PRINFMP	FFX	AAAf/S3(me	594,310,419	13.02 %
51	PRINMAS	FFX	AAAf/S4(me	591,531,221	12.95 %
51	PRINGLP	FFX	AAAf/S5(me	521,572,885	11.42 %
51	PRINFTR	FFX	AAAf/S5(me	430,352,824	9.42 %
51	PRINHYD	FFX	NO APLICA	202,350,576	4.43 %
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			557,632,324	12.21%
1ISP	EEM	*	N/A	113,774,280	2.49 %
1ISP	EZU	*	N/A	87,618,618	1.92 %
1ISP	VOO	*	N/A	72,421,357	1.59 %
1ISP	VDST	N	N/A	67,689,794	1.48 %
1ISP	LQD	*	N/A	42,624,451	0.93 %
1ISP	VTV	*	N/A	38,702,227	0.85 %
1ISP	EWC	*	N/A	38,181,971	0.84 %
1ISP	IVV	*	N/A	24,788,768	0.54 %
1ISP	MCHI	*	N/A	22,035,383	0.48 %
1ISP	EWZ	*	N/A	18,936,827	0.41 %
1ISP	KWEB	*	N/A	6,931,025	0.15 %
1ISP	HERO	*	N/A	3,937,803	0.09 %
1ISP	WTAI	N	N/A	3,554,777	0.08 %
1ISP	FIVG	*	N/A	3,296,837	0.07 %
1ISP	QQQ	*	N/A	3,247,899	0.07 %
1ISP	ICLN	*	N/A	3,121,885	0.07 %
1ISP	WCLD	*	N/A	3,121,701	0.07 %
1ISP	FINX	*	N/A	2,212,980	0.05 %
1ISP	VOLT	N	N/A	1,433,741	0.03 %
	Udibonos			231,533,399	5.07%
	UDIS				
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	192,624,810	4.22 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	38,908,589	0.85 %
	Reportos			28,431,579	0.62%
BI	CETES	220331	AAA(mex)	28,431,579	0.62 %
	TOTAL CARTERA			4,566,306,729	100.00%
	ACTIVO NETO			4,338,188,706	-
	VAR ESTABLECIDO \$			49,021,532	1.13%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			18,350,306	0.42%
	Cartera al:		6/17/2021		-

EL VALOR EN RIESGO (VAR POR SUS SIGLAS EN INGLÉS) ES CALCULADO UTILIZANDO EL MÉTODO MONTECARLO, CONSIDERANDO 250 PERÍODOS DE HISTORIA Y GENERANDO 1000 ESCENARIOS DE LOS PRINCIPALES FACTORES DE RIESGO QUE AFECTAN EL VALOR DE LOS ACTIVOS QUE COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.